

Escenarios fijos aplicables a la estimación del Diferencial del Valor en Riesgo Condicional y a la Provisión por Exposición a Instrumentos Derivados

Con fundamento en los artículos 1, 2, 5, fracción XVI, 43 párrafo cuarto y 45 de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro (LSAR), el Anexo L de las Disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las Sociedades de Inversión Especializadas de Fondos para el Retiro, los Anexos A y N de las Disposiciones de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro, así como en los acuerdos aprobados en la Cuadragésima Quinta Sesión Ordinaria del Comité de Análisis de Riesgos de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, celebrada el 20 de mayo de 2021, por este medio se dan a conocer los escenarios de estrés fijos que las Sociedades de Inversión deberán utilizar para el cómputo del Diferencial del Valor en Riesgo Condicional y la Provisión por Exposición en Instrumentos Derivados.

Los escenarios fijos aplicables a la estimación del Diferencial del Valor en Riesgo Condicional y a la Provisión por Exposición a Instrumentos Derivados, mismos que entran en vigor a partir del 25 de octubre de 2021, son los siguientes:

ESCENARIOS PARA EL CÁLCULO	
Escenarios de estrés (7 observaciones)	
1	10 de octubre de 2008
2	22 de octubre de 2008
3	23 de octubre de 2008
4	24 de octubre de 2008
5	12 de noviembre de 2008
6	20 de febrero de 2009
7	12 de marzo de 2020
Ventana fija (993 observaciones restantes)	
8 al 1,000	Del 22 de enero de 2010 al 31 de diciembre de 2013